

# صندوق سرمایه‌گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

## افشای اطلاعات ماهانه پرتفوی

### منتهی به تاریخ ۳۱ خردادماه ۱۳۹۷

باسلام

به پیوست، گزارش افشای ماهانه پرتفوی "صندوق سرمایه‌گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه" مربوط به دوره مالی منتهی به تاریخ ۳۱ خردادماه ۱۳۹۷ در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ سازمان بورس و اوراق بهادار مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ براساس مدارک و اطلاعات موجود تا تاریخ ۱۰ تیرماه ۱۳۹۷، تهیه و تنظیم گردیده است.

باتشکر

مدیر صندوق

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه  
 صورت وضعیت پرتفوی  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۷/۰۳/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۲/۳۱			شرکت
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	فروش طی دوره تعداد	خرید طی دوره تعداد	بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
۸۹.۳۴٪	۱۴۰,۰۰۹,۳۱۳,۰۷۰	۱۱۰,۴۰۱,۶۶۲,۱۷۹	۱۶۷,۸۷۴	۸۰,۳۶۰,۵۹۲	-	-	۲,۱۸۸,۹۶۴,۹۴۲	۱,۳۵۲,۳۷۶	۱۱۹,۵۳۳,۵۸۶,۹۸۹	۱۰۸,۴۱۲,۶۹۷,۲۳۷	۷۹,۰۰۰,۸۲۱,۶	جمع



صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه  
صورت وضعیت پرتفوی  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۲- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۳۹۷/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره						۱۳۹۷/۰۳/۳۱		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت								
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود مؤثر	نوع سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	بذرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده										
۲.۴۴٪	۳,۳۲۶,۷۳۳,۶۱۲	۳,۷۸۸,۴۷۷,۴۳۳	۸۵۱,۰۰۰	۴۵۰۰	-	-	-	-	۶,۸۰۷,۱۶۱,۳۲۷	۶,۸۱۹,۳۵۹,۳۷۹	۸,۱۰۰	-٪	-٪	۱۳۹۶/۰۷/۱۷	۱۳۹۶/۰۷/۱۷	بورس	بلی	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۱۲۸
۶.۱۱٪	۹,۵۷۹,۰۵۰,۱۵۰	۸,۹۱۸,۴۶۱,۳۰۰	۹۵۸,۶۰۰	۱۰,۰۰۰	-	-	-	-	۹,۴۱۹,۴۱۵,۹۶۸	۸,۹۱۸,۴۶۱,۳۰۰	۱۰,۰۰۰	-٪	-٪	۱۳۹۶/۰۹/۱۹	۱۳۹۶/۰۹/۱۹	فرابورس	بلی	اسناد خزانه - بودجه ۹۶-۹۷-۹۸-۹۹
۸.۵۵٪	۱۲,۴۰۵,۷۷۳,۷۶۲	۱۲,۷۰۶,۹۳۸,۶۳۳	۱,۸۰۹,۶۰۰	۱۴,۵۰۰	-	-	-	-	۱۶,۲۳۶,۵۷۷,۱۹۵	۱۵,۷۳۷,۷۲۰,۵۷۹	۱۸,۱۰۰							جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

(بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱

نام اوراق بهادار	تعداد	قیمت پایانی	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۴-۱- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۲/۳۱				گواهی سپرده بانکی			
خالص ارزش	درصد به کل دارایی‌ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش	بهای تمام شده	تعداد	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس		نرخ شکست	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید
.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....
.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....	.....

گواهی سپرده بانکی نزد بانک .....  
جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۰۲/۳۱		مشخصات حساب بانکی			سپرده های بانکی
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	
۰.۰۳٪	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۹۱,۳۶۷,۱۷۸	۶,۰۹۱,۳۶۷,۱۷۸	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	-	۱۳۹۳/۰۴/۲۵	جاری	۱۰۰۵-۱۱-۰۴۰-۰۰۳۰۰۳۰-۱	خاورمیانه مهستان
۰.۶۸٪	۱,۰۶۶,۶۵۰,۳۲۴	۶,۱۳۷,۹۰۷,۴۲۳	۴,۹۴۳,۱۷۲,۴۳۱	۲,۲۶۱,۳۸۵,۳۱۶	-	۱۳۹۳/۰۴/۲۵	کوتاه مدت	۱۰۰۵-۱۰-۸۱۰-۰۰۳۰۰۳۰-۱	خاورمیانه مهستان
۱٪	۱۱۱۶۶۵۰۳۲۴	۱۲,۲۲۹,۲۷۴,۶۰۱	۱۱,۰۳۴,۵۳۹,۶۰۹	۲,۳۱۱,۳۸۵,۳۱۶					جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	۱۰,۵۱۴,۳۱۳,۹۱۱	۹۲.۸۷%	۶.۶۸%
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۶۴۵,۶۹۹,۳۲۷	۵.۷۰%	۰.۴۱%
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۴۸,۱۸۴,۲۱۰	۰.۴۳%	۰.۰۳%
سایر درآمدها	۴-۲	۱۱۳,۳۴۵,۰۱۸	۱.۰۰%	۰.۰۷%
جمع		۱۱,۳۲۱,۵۴۲,۴۶۶	۱۰۰%	۷.۱۹%



صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه				سهام
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت 2-1-2	یادداشت 1-1-2	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت 2-1-2	یادداشت 1-1-2	
۹۲.۳۹٪	۱۰.۵۱۴.۳۱۳.۹۱۱	(۱۳۵.۷۹۳.۴۱۲)	۷.۶۶۳.۲۹۳.۰۸۳	۹۹٪	۱۹.۸۶۱.۱۱۰.۴۴۰	-	۱۸.۲۸۷.۷۶۱.۱۴۰	۱.۵۷۳.۳۴۹.۳۰۰
			۲.۹۸۶.۸۱۴.۲۴۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۱-۲-درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه		طی خرداد ماه		اطلاعات مجمع				
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	نام سهام
۵۵۹,۷۳۳,۹۹۳	۸۹,۷۰۶,۸۰۷	۶۴۹,۴۴۰,۸۰۰	۵۵۹,۷۳۳,۹۹۳	۸۹,۷۰۶,۸۰۷	۶۴۹,۴۴۰,۸۰۰	۶۸۰	۱,۷۱۳,۶۰۲	جمع

**صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱**

**۲-۱-۲-درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار**

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه				شرح
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	
(۷,۱۱۰,۹۰۶,۰۳۰)	۱۵,۶۴۳,۹۹۳,۲۶۶	۸,۵۳۳,۰۸۷,۲۳۶	۲۸,۷۲۳,۶۸۰	-	-	-	-	ح. س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین
۷,۶۶۳,۲۹۳,۰۸۳	۱۲۴,۱۸۶,۱۱۰,۹۳۱	۱۳۱,۸۴۹,۴۰۴,۰۰۷	۷۲,۱۱۲,۰۹۲	۱۸,۲۸۷,۷۶۱,۱۴۰	۱۰۳,۴۱۶,۳۰۹,۸۰۴	۱۲۱,۷۰۴,۰۷۰,۹۴۱	۴۲,۸۸۳,۴۱۲	جمع درآمد ناشی از تغییر قیمت سهام
۱۲۹,۵۰۶,۰۴۰	۳,۶۹۷,۲۱۷,۵۷۲	۳,۸۲۶,۷۲۳,۶۱۲	۴,۵۰۰	(۲۲,۶۶۳,۵۵۶)	۳,۸۴۹,۳۸۷,۱۶۹	۳,۸۲۶,۷۲۳,۶۱۲	۴,۵۰۰	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸
۳۸۵,۷۲۰,۱۵۰	۹,۱۹۳,۳۳۰,۰۰۰	۹,۵۷۹,۰۵۰,۱۵۰	۱۰,۰۰۰	۱۵۹,۶۳۴,۱۸۲	۹,۴۱۹,۴۱۵,۹۶۸	۹,۵۷۹,۰۵۰,۱۵۰	۱۰,۰۰۰	اسناد خزانه-م.آبودجه ۹۶-۹۷۰۶۱۲
۸,۱۷۸,۵۱۹,۲۷۳	۱۳۷,۰۷۶,۶۵۸,۵۰۳	۱۴۵,۲۵۵,۱۷۷,۷۶۹	۷۲,۱۲۶,۵۹۲	۱۸,۴۲۴,۷۳۱,۷۶۶	۱۱۶,۶۸۵,۱۱۲,۹۴۱	۱۳۵,۱۰۹,۸۴۴,۷۰۳	۴۲,۸۹۷,۹۱۲	

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲-۱-۳- سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه				شرح
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص بهای فروش	تعداد	
(۱۳۵,۷۹۳,۴۱۲)	۵,۶۳۴,۵۹۹,۵۶۷	۵,۴۹۸,۸۰۶,۱۵۴	۴,۳۵۸,۵۱۱	-	-	-	-	سود (زیان) حاصل از فروش سهام
۸۸,۰۰۸,۹۴۶	۲,۹۵۷,۷۷۴,۰۵۸	۳,۰۴۵,۷۸۳,۰۰۴	۳,۶۰۰	۸۸,۰۰۸,۹۴۶	۲,۹۵۷,۷۷۴,۰۵۸	۳,۰۴۵,۷۸۳,۰۰۴	۳,۶۰۰	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸
۴۲,۴۶۴,۱۹۱	۴,۵۹۶,۶۶۵,۰۰۰	۴,۶۳۹,۱۲۹,۱۹۱	۵,۰۰۰	-	-	-	-	اسناد خزانه - م ۲ بوجه ۹۶-۹۷۰۶۱۲
(۵,۳۲۰,۳۷۵)	۱۳,۱۸۹,۰۳۸,۶۲۵	۱۳,۱۸۳,۷۱۸,۳۴۹	۴,۳۶۷,۱۱۱	۸۸,۰۰۸,۹۴۶	۲,۹۵۷,۷۷۴,۰۵۸	۳,۰۴۵,۷۸۳,۰۰۴	۳,۶۰۰	

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲-۲- درآمدها حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق
درصد از کل دارائیهها	مبلغ	یادداشت 2-1-2	یادداشت 1-1-2	درصد از کل دارائیهها	مبلغ	یادداشت 2-1-2	یادداشت 1-1-2
۰.۰۰	۲۱۷,۵۱۴,۹۸۶	۸۸,۰۰۸,۹۴۶	۱۲۹,۵۰۶,۰۴۰	۰.۰۴٪	۶۵,۳۴۵,۳۹۰	۸۸,۰۰۸,۹۴۶	(۲۲,۶۶۳,۵۵۶)
۰.۰۰	۴۲۸,۱۸۴,۳۴۱	۴۲,۴۶۴,۱۹۱	۳۸۵,۷۲۰,۱۵۰	۰.۱۰٪	۱۵۹,۶۳۴,۱۸۲	-	۱۵۹,۶۳۴,۱۸۲
-	۶۴۵,۶۹۹,۳۲۷	۱۳۰,۴۷۳,۱۳۷	۵۱۵,۲۲۶,۱۹۰	۰.۱۴٪	۲۲۴,۹۷۹,۵۷۲	۸۸,۰۰۸,۹۴۶	۱۳۶,۹۷۰,۶۲۶

اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸

اسناد خزانه - م ۲ بودجه ۹۶-۹۷-۹۸

جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲-۲-۱- سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه			طی اردیبهشت ماه			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود			
-	-	-	-	-	-	۰٪		
۰	۰	۰	۰	۰	۰			

شرح

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲-۳- در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه		طی خرداد ماه		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده پادداشت 1-2-2	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده پادداشت 1-2-2	شماره حساب	نام سپرده
۲۸.۲۸٪	۴۸,۱۸۴,۲۱۰	۰.۰۰٪	۱۴,۵۳۸,۹۷۷	۱۰۰۵-۱۰-۸۱۰۰۰۰۰۳۰۰۳۰-۱	خاورمیانه مهستان
۲۸.۲۸٪	۴۸,۱۸۴,۲۱۰	۰.۰۰٪	۱۴,۵۳۸,۹۷۷		جمع

صندوق سرمایه گذاری شاخص سی شرکت بزرگ فیروزه  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

**۲-۴- سایر درآمدها:**

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه	طی خرداد ماه	
مبلغ	مبلغ	سایر درآمدها
۱۱۳,۳۴۵,۰۱۸	-	سایر درآمدها
۱۱۳,۳۴۵,۰۱۸	-	جمع